

平成28年4月期（平成27年10月8日～平成28年4月7日）決算短信

平成28年5月18日

上場取引所 東証

ファンド名 NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信
 コード番号 (1591)
 連動対象指標 JPX日経インデックス400
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>
 代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
 問合せ先責任者 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成28年6月30日
 分配金支払開始日 平成28年5月16日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年4月期の運用状況（平成27年10月8日～平成28年4月7日）

(1)資産内訳 (百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
平成28年4月期	226,826	(97.7)	5,280	(2.3)	232,106	(100)
平成27年10月期	224,563	(98.3)	3,844	(1.7)	228,408	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前特定期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当特定期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成28年4月期	17,053	5,893	2,746	20,201
平成27年10月期	14,887	5,893	3,727	17,053

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当り基準価額 (③/①)
	百万円	百万円	百万円	円
平成28年4月期	252,126	20,019	232,106	11,490
平成27年10月期	245,707	17,298	228,408	13,393

(4)分配金

	1口当り分配金
	円
平成28年4月期	119.00
平成27年10月期	109.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有・~~無~~
 ② ①以外の変更 有・~~無~~

II 財務諸表等

NEXT FUNDS JPX日経インデックス400連動型上場投信

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (平成27年10月7日現在)	第5期 (平成28年4月7日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	-	18,694,373,424
コール・ローン	17,307,250,100	1,452,049,395
株式	224,563,483,780	226,826,185,830
派生商品評価勘定	70,499,484	-
未収入金	1,881,967,700	2,295,281,083
未収配当金	1,742,359,133	2,346,282,871
未収利息	14,023	110
その他未収収益	1,976,576	5,768,358
差入委託証拠金	139,705,200	506,539,602
流動資産合計	245,707,255,996	252,126,480,673
資産合計	245,707,255,996	252,126,480,673
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	267,817,518
未払収益分配金	1,858,871,503	2,403,973,978
未払受託者報酬	63,758,757	69,274,101
未払委託者報酬	192,262,912	209,839,528
未払利息	270,585	-
有価証券貸借取引受入金	15,108,913,575	17,040,187,499
その他未払費用	74,727,402	28,408,020
流動負債合計	17,298,804,734	20,019,500,644
負債合計	17,298,804,734	20,019,500,644
純資産の部		
元本等		
元本	198,268,257,742	234,862,197,212
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	30,140,193,520	△2,755,217,183
(分配準備積立金)	5,728,750	11,864,702
元本等合計	228,408,451,262	232,106,980,029
純資産合計	228,408,451,262	232,106,980,029
負債純資産合計	245,707,255,996	252,126,480,673

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自 平成27年4月8日 至 平成27年10月7日	第5期 自 平成27年10月8日 至 平成28年4月7日
営業収益		

受取配当金	2,160,694,552	2,735,943,663
受取利息	2,468,785	4,768,818
有価証券売買等損益	△16,074,707,636	△36,129,351,754
派生商品取引等損益	△244,376,044	△649,522,566
その他収益	12,550,123	24,646,215
営業収益合計	△14,143,370,220	△34,013,515,624
営業費用		
支払利息	1,099,651	2,350,203
受託者報酬	63,758,757	69,274,101
委託者報酬	192,262,912	209,839,528
その他費用	60,617,331	73,784,934
営業費用合計	317,738,651	355,248,766
営業利益又は営業損失(△)	△14,461,108,871	△34,368,764,390
経常利益又は経常損失(△)	△14,461,108,871	△34,368,764,390
当期純利益又は当期純損失(△)	△14,461,108,871	△34,368,764,390
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金(△)	40,786,039,313	30,140,193,520
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,480,809,543	7,522,135,011
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,480,809,543	7,522,135,011
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,806,674,962	3,644,807,346
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,806,674,962	3,644,807,346
分配金	1,858,871,503	2,403,973,978
期末剰余金又は期末欠損金(△)	30,140,193,520	△2,755,217,183

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成 27 年 10 月 8 日から平成 28 年 4 月 7 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第 4 期 平成 27 年 10 月 7 日現在	第 5 期 平成 28 年 4 月 7 日現在
-----------------------------	----------------------------

1. 計算期間の末日における受益権の総数 17,053,867 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 20,201,462 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 13,393 円	2. 投資信託財産計算規則第 55 条の 6 第 1 項第 10 号に規定する額 元本の欠損 2,755,217,183 円
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 14,665,551,450 円	3. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 11,490 円
	4. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 16,275,485,960 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日			第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	2,174,613,809 円	当期配当等収益額	A	2,763,008,493 円
分配準備積立金	B	6,625,444 円	分配準備積立金	B	5,728,750 円
配当等収益合計額	C=A+B	2,181,239,253 円	配当等収益合計額	C=A+B	2,768,737,243 円
経費	D	316,639,000 円	経費	D	352,898,563 円
収益分配可能額	E=C-D	1,864,600,253 円	収益分配可能額	E=C-D	2,415,838,680 円
収益分配金	F	1,858,871,503 円	収益分配金	F	2,403,973,978 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,728,750 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	11,864,702 円
口数	H	17,053,867 口	口数	H	20,201,462 口
1 口当たり分配金	I=F/H	109 円	1 口当たり分配金	I=F/H	119 円
2. その他費用 その他費用のうち 50,217,571 円は、対象指数についての商標使用料であります。			2. その他費用 その他費用のうち 53,935,926 円は、対象指数についての商標使用料であります。		

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日		第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日	
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		1. 金融商品に対する取組方針 同左	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。		2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左	
3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。		3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左	

○信用リスクの管理
信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。

○流動性リスクの管理
流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

第 4 期 平成 27 年 10 月 7 日現在	第 5 期 平成 28 年 4 月 7 日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2. 時価の算定方法 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日
期首元本額 173,080,726,384 円	期首元本額 198,268,257,742 円
期中追加設定元本額 68,517,726,366 円	期中追加設定元本額 68,522,527,904 円
期中一部交換元本額 43,330,195,008 円	期中一部交換元本額 31,928,588,434 円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 4 期 自 平成 27 年 4 月 8 日 至 平成 27 年 10 月 7 日	第 5 期 自 平成 27 年 10 月 8 日 至 平成 28 年 4 月 7 日
	損益に含まれた評価差額 (円)	損益に含まれた評価差額 (円)
株式	△15,709,835,095	△34,645,600,612
合計	△15,709,835,095	△34,645,600,612

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第 4 期(平成 27 年 10 月 7 日現在)			第 5 期(平成 28 年 4 月 7 日現在)		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
	うち 1 年超			うち 1 年超		
市場取引						

株価指数先物取引								
買建	3,573,898,200	—	3,644,838,000	70,499,484	5,467,303,602	—	5,200,218,000	△267,817,518
合計	3,573,898,200	—	3,644,838,000	70,499,484	5,467,303,602	—	5,200,218,000	△267,817,518

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成 28 年 4 月 7 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	国際石油開発帝石	961,500	794.00	763,431,000	
		安藤・間	121,800	535.00	65,163,000	
		コムシスホールディングス	78,500	1,644.00	129,054,000	貸付有価証券 1,500株(500株)
		ミサワホーム	21,600	703.00	15,184,800	貸付有価証券 14,600株
		大成建設	948,000	721.00	683,508,000	
		大林組	547,400	1,061.00	580,791,400	貸付有価証券 5,900株(5,900株)
		清水建設	558,000	949.00	529,542,000	貸付有価証券 60,000株
		長谷工コーポレーション	213,000	989.00	210,657,000	
		鹿島建設	856,000	672.00	575,232,000	
		三井住友建設	699,400	96.00	67,142,400	貸付有価証券 165,400株
		大東建託	68,200	16,460.00	1,122,572,000	貸付有価証券 7,700株(7,700株)
		NIPPON	42,000	1,745.00	73,290,000	
		住友林業	125,600	1,254.00	157,502,400	
		大和ハウス工業	539,200	3,021.00	1,628,923,200	
		積水ハウス	610,200	1,853.50	1,131,005,700	
		協和エクシオ	71,500	1,189.00	85,013,500	
		日揮	183,000	1,610.00	294,630,000	
		千代田化工建設	132,000	782.00	103,224,000	貸付有価証券 37,000株
		カルビー	67,700	4,125.00	279,262,500	

ヤクルト本社	97,900	4,750.00	465,025,000	貸付有価証券 29,300株 (27,200 株)
明治ホールディングス	108,100	8,820.00	953,442,000	
日本ハム	134,000	2,349.00	314,766,000	貸付有価証券 9,000株 (9,000株)
アサヒグループホールディングス	342,400	3,339.00	1,143,273,600	貸付有価証券 86,100株
麒麟ホールディングス	739,700	1,524.00	1,127,302,800	貸付有価証券 189,000株
伊藤園	54,100	3,495.00	189,079,500	貸付有価証券 36,600株
キッコーマン	138,000	3,520.00	485,760,000	
味の素	383,900	2,500.00	959,750,000	
キューピー	92,900	2,791.00	259,283,900	貸付有価証券 17,700株
ニチレイ	195,000	938.00	182,910,000	
東洋水産	89,700	3,895.00	349,381,500	貸付有価証券 3,600株
日清食品ホールディングス	77,200	5,100.00	393,720,000	
日本たばこ産業	1,060,700	4,561.00	4,837,852,700	貸付有価証券 421,500株
東レ	1,238,000	906.50	1,122,247,000	貸付有価証券 218,000株
王子ホールディングス	700,000	418.00	292,600,000	貸付有価証券 46,000株
大王製紙	75,500	907.00	68,478,500	貸付有価証券 51,100株 (600株)
クラレ	269,200	1,275.00	343,230,000	貸付有価証券 153,200株
旭化成	1,064,000	709.60	755,014,400	
住友化学	1,256,000	456.00	572,736,000	
日産化学工業	102,600	2,798.00	287,074,800	
東ソー	460,000	438.00	201,480,000	
デンカ	354,000	450.00	159,300,000	
信越化学工業	306,000	5,707.00	1,746,342,000	
エア・ウォーター	141,000	1,538.00	216,858,000	
大陽日酸	131,400	963.00	126,538,200	貸付有価証券 88,900株 (500株)
日本パーカライジング	87,200	958.00	83,537,600	
J S R	160,100	1,493.00	239,029,300	
三菱ケミカルホールディングス	1,142,800	523.70	598,484,360	
日本合成化学工業	40,000	659.00	26,360,000	

ダイセル	240,000	1,434.00	344,160,000	
積水化学工業	387,300	1,327.00	513,947,100	
日本ゼオン	147,000	665.00	97,755,000	
アイカ工業	51,300	2,198.00	112,757,400	
宇部興産	913,000	185.00	168,905,000	
日立化成	84,300	1,788.00	150,728,400	
日本化薬	111,000	1,072.00	118,992,000	貸付有価証券 10,000株
日油	130,000	773.00	100,490,000	
花王	458,900	5,650.00	2,592,785,000	貸付有価証券 131,200株
日本ペイントホールディングス	131,700	2,311.00	304,358,700	貸付有価証券 55,500株
関西ペイント	193,100	1,793.00	346,228,300	貸付有価証券 16,200株
D I C	674,000	240.00	161,760,000	
富士フイルムホールディングス	390,500	4,074.00	1,590,897,000	
資生堂	323,700	2,394.50	775,099,650	貸付有価証券 78,500株
コーセー	27,600	10,720.00	295,872,000	
シーズ・ホールディングス	21,500	2,243.00	48,224,500	貸付有価証券 100株
小林製薬	25,800	9,240.00	238,392,000	貸付有価証券 300株
日東電工	131,800	5,728.00	754,950,400	貸付有価証券 600株
ニフコ	32,600	5,090.00	165,934,000	貸付有価証券 3,000株 (3,000株)
ユニ・チャーム	345,400	2,346.50	810,481,100	貸付有価証券 86,600株 (43,400株)
協和発酵キリン	204,100	1,768.00	360,848,800	貸付有価証券 77,900株
武田薬品工業	679,500	5,155.00	3,502,822,500	貸付有価証券 24,500株
アステラス製薬	1,910,500	1,420.50	2,713,865,250	
塩野義製薬	248,600	5,230.00	1,300,178,000	
田辺三菱製薬	198,800	1,909.00	379,509,200	
中外製薬	169,900	3,365.00	571,713,500	
科研製薬	29,400	6,770.00	199,038,000	
エーザイ	210,000	6,850.00	1,438,500,000	貸付有価証券 14,800株
ロート製薬	83,500	1,960.00	163,660,000	

小野薬品工業	387,500	4,892.00	1,895,650,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
久光製薬	52,900	4,940.00	261,326,000	
持田製薬	11,700	8,010.00	93,717,000	
参天製薬	314,200	1,630.00	512,146,000	
ツムラ	53,700	2,681.00	143,969,700	貸付有価証券 35,900株
沢井製薬	29,000	6,820.00	197,780,000	
第一三共	573,800	2,514.50	1,442,820,100	
キョーリン製薬ホールディングス	45,500	2,099.00	95,504,500	
大塚ホールディングス	366,800	3,986.00	1,462,064,800	
大正製薬ホールディングス	41,000	8,640.00	354,240,000	貸付有価証券 200株
昭和シェル石油	171,600	937.00	160,789,200	貸付有価証券 19,700株
横浜ゴム	102,900	1,708.00	175,753,200	貸付有価証券 60,000株
東洋ゴム工業	77,200	1,475.00	113,870,000	貸付有価証券 3,200株
ブリヂストン	575,800	3,916.00	2,254,832,800	貸付有価証券 244,900株
住友ゴム工業	159,700	1,588.00	253,603,600	貸付有価証券 84,200株
旭硝子	900,000	561.00	504,900,000	貸付有価証券 190,000株
太平洋セメント	1,064,000	252.00	268,128,000	
TOTO	125,300	3,325.00	416,622,500	
日本碍子	215,000	1,831.00	393,665,000	
日本特殊陶業	147,000	1,889.00	277,683,000	
新日鐵住金	769,100	2,041.00	1,569,733,100	貸付有価証券 164,100株(38,800株)
神戸製鋼所	3,133,000	96.00	300,768,000	貸付有価証券 397,000株(297,000株)
ジェイ エフ イー ホールディングス	466,200	1,458.00	679,719,600	
日立金属	195,200	1,094.00	213,548,800	
三井金属鉱業	435,000	166.00	72,210,000	
三菱マテリアル	1,064,000	296.00	314,944,000	貸付有価証券 93,000株
住友金属鉱山	471,000	1,048.50	493,843,500	
DOWAホールディングス	219,000	616.00	134,904,000	

住友電気工業	682,700	1,245.00	849,961,500	
アサヒホールディングス	25,700	1,368.00	35,157,600	
三和ホールディングス	169,200	812.00	137,390,400	
三協立山	22,300	1,433.00	31,955,900	貸付有価証券 6,400株
リンナイ	31,700	9,630.00	305,271,000	貸付有価証券 1,900株
日本発條	160,500	963.00	154,561,500	貸付有価証券 16,200株 (16,200 株)
オーエスジー	77,700	1,888.00	146,697,600	貸付有価証券 52,500株 (44,900 株)
ディスコ	21,700	9,190.00	199,423,000	
ニューフレアテクノロジー	3,000	4,890.00	14,670,000	貸付有価証券 1,600株 (1,600株)
ナブテスコ	88,600	2,316.00	205,197,600	
SMC	51,100	24,175.00	1,235,342,500	
小松製作所	835,800	1,742.50	1,456,381,500	貸付有価証券 54,900株
住友重機械工業	497,000	415.00	206,255,000	
日立建機	76,200	1,655.00	126,111,000	貸付有価証券 33,100株 (700株)
クボタ	818,600	1,350.50	1,105,519,300	貸付有価証券 196,500株
荏原製作所	377,000	464.00	174,928,000	貸付有価証券 7,000株 (7,000株)
ダイキン工業	237,200	8,015.00	1,901,158,000	
椿本チエイン	97,000	635.00	61,595,000	
タダノ	78,600	939.00	73,805,400	
平和	50,500	2,270.00	114,635,000	
ユニバーサルエンターテインメント	16,200	1,721.00	27,880,200	貸付有価証券 2,600株
セガサミーホールディングス	175,100	1,152.00	201,715,200	
T P R	20,000	2,653.00	53,060,000	貸付有価証券 1,300株
ホシザキ電機	47,600	9,250.00	440,300,000	
日本精工	334,600	875.00	292,775,000	貸付有価証券 8,800株
ジェイテクト	173,600	1,298.00	225,332,800	
不二越	151,000	321.00	48,471,000	貸付有価証券 102,000株
T H K	108,300	2,004.00	217,033,200	貸付有価証券 400株

イーグル工業	20,100	1,353.00	27,195,300	
マキタ	106,200	6,570.00	697,734,000	
三菱重工業	2,901,000	377.60	1,095,417,600	
I H I	1,252,000	199.00	249,148,000	貸付有価証券 291,000株(29,000 株)
コニカミノルタ	406,800	883.00	359,204,400	貸付有価証券 10,000株
ブラザー工業	210,600	1,215.00	255,879,000	
ミネベア	262,000	769.00	201,478,000	
日立製作所	4,156,000	468.50	1,947,086,000	
三菱電機	1,738,000	1,090.50	1,895,289,000	
富士電機	491,000	356.00	174,796,000	
安川電機	202,300	1,250.00	252,875,000	貸付有価証券 127,600株
日本電産	196,000	7,262.00	1,423,352,000	貸付有価証券 27,500株
オムロン	184,000	3,115.00	573,160,000	
日本電気	2,240,000	266.00	595,840,000	
富士通	1,571,000	369.50	580,484,500	
沖電気工業	706,000	141.00	99,546,000	貸付有価証券 99,000株
セイコーエプソン	242,600	1,680.00	407,568,000	
ワコム	128,300	442.00	56,708,600	貸付有価証券 67,400株
パナソニック	1,861,100	879.20	1,636,279,120	貸付有価証券 259,800株
アンリツ	97,800	563.00	55,061,400	貸付有価証券 8,900株
富士通ゼネラル	50,000	1,762.00	88,100,000	
日立国際電気	37,300	1,197.00	44,648,100	
T D K	98,300	5,720.00	562,276,000	
アルプス電気	138,300	1,673.00	231,375,900	
ヒロセ電機	26,300	12,090.00	317,967,000	貸付有価証券 300株(300株)
日本航空電子工業	47,000	1,130.00	53,110,000	
横河電機	163,000	1,076.00	175,388,000	貸付有価証券 9,200株(9,200株)
日本光電工業	68,100	2,655.00	180,805,500	貸付有価証券 29,700株(10,400 株)
堀場製作所	30,100	3,950.00	118,895,000	貸付有価証券 9,200株

キーエンス	36,900	59,990.00	2,213,631,000	貸付有価証券 500株 (500株)
シスメックス	126,400	6,690.00	845,616,000	
スタンレー電気	116,900	2,226.00	260,219,400	貸付有価証券 1,800株
カシオ計算機	163,300	2,081.00	339,827,300	貸付有価証券 98,700株
ファナック	166,700	16,500.00	2,750,550,000	貸付有価証券 22,500株
エンプラス	8,300	3,770.00	31,291,000	貸付有価証券 500株 (500株)
浜松ホトニクス	127,100	3,025.00	384,477,500	貸付有価証券 37,300株
京セラ	267,400	4,630.00	1,238,062,000	
村田製作所	170,900	12,690.00	2,168,721,000	貸付有価証券 15,500株
小糸製作所	97,600	4,670.00	455,792,000	
ミツバ	27,700	1,480.00	40,996,000	
キヤノン	877,000	3,131.00	2,745,887,000	貸付有価証券 103,100株
リコー	527,500	1,057.00	557,567,500	
東京エレクトロン	133,700	6,778.00	906,218,600	
トヨタ紡織	57,000	1,753.00	99,921,000	
ユニプレス	33,800	1,747.00	59,048,600	
豊田自動織機	148,300	4,545.00	674,023,500	
デンソー	402,400	4,006.00	1,612,014,400	
東海理化電機製作所	47,700	1,847.00	88,101,900	
三井造船	630,000	148.00	93,240,000	貸付有価証券 81,000株
川崎重工業	1,268,000	281.00	356,308,000	
名村造船所	48,900	753.00	36,821,700	貸付有価証券 19,600株 (200株)
日産自動車	2,286,600	946.20	2,163,580,920	
いすゞ自動車	472,000	1,046.50	493,948,000	
トヨタ自動車	476,500	5,424.00	2,584,536,000	
日野自動車	232,500	1,084.00	252,030,000	貸付有価証券 5,200株 (5,200株)
三菱自動車工業	646,800	787.00	509,031,600	
NOK	78,800	1,673.00	131,832,400	
カルソニックカンセイ	124,000	710.00	88,040,000	
アイシン精機	164,000	4,000.00	656,000,000	
マツダ	515,800	1,463.50	754,873,300	

ダイハツ工業	194,400	1,428.00	277,603,200	貸付有価証券 64,600株(36,900株)
本田技研工業	1,094,600	2,852.00	3,121,799,200	
スズキ	340,500	2,910.00	990,855,000	
富士重工業	514,800	3,398.00	1,749,290,400	
ヤマハ発動機	230,100	1,634.00	375,983,400	貸付有価証券 48,200株(1,100株)
エクセディ	22,100	2,191.00	48,421,100	貸付有価証券 2,600株(1,300株)
豊田合成	59,200	1,927.00	114,078,400	
日本精機	43,000	1,874.00	80,582,000	貸付有価証券 17,000株
シマノ	65,700	17,040.00	1,119,528,000	
テイ・エス テック	37,800	2,376.00	89,812,800	
テルモ	249,700	3,985.00	995,054,500	
ニコン	304,100	1,638.00	498,115,800	貸付有価証券 85,500株(35,300株)
トプコン	54,700	1,346.00	73,626,200	貸付有価証券 36,900株(200株)
オリンパス	242,700	4,120.00	999,924,000	貸付有価証券 7,100株
HOYA	368,400	4,132.00	1,522,228,800	
セイコーホールディングス	105,000	409.00	42,945,000	
バンダイナムコホールディングス	168,400	2,338.00	393,719,200	
パイロットコーポレーション	28,400	3,990.00	113,316,000	
アシックス	151,700	1,895.00	287,471,500	貸付有価証券 96,300株(5,000株)
ヤマハ	119,700	3,280.00	392,616,000	貸付有価証券 2,000株(1,000株)
ピジョン	92,300	2,749.00	253,732,700	貸付有価証券 62,400株
電源開発	138,900	3,275.00	454,897,500	
東京瓦斯	1,818,000	480.60	873,730,800	
大阪瓦斯	1,686,000	397.60	670,353,600	
東武鉄道	870,000	546.00	475,020,000	貸付有価証券 66,000株(66,000株)
相鉄ホールディングス	372,000	689.00	256,308,000	
東京急行電鉄	948,000	943.00	893,964,000	
小田急電鉄	522,000	1,186.00	619,092,000	貸付有価証券 83,000株(5,000株)

京王電鉄	455,000	957.00	435,435,000	貸付有価証券 26,000株
京成電鉄	244,000	1,527.00	372,588,000	貸付有価証券 6,000株(2,000株)
東日本旅客鉄道	297,800	9,407.00	2,801,404,600	貸付有価証券 79,200株(79,200 株)
西日本旅客鉄道	156,800	6,400.00	1,003,520,000	
東海旅客鉄道	145,900	18,895.00	2,756,780,500	
西日本鉄道	281,000	706.00	198,386,000	
近鉄グループホールディングス	1,639,000	446.00	730,994,000	
阪急阪神ホールディングス	1,093,000	688.00	751,984,000	
南海電気鉄道	488,000	587.00	286,456,000	
京阪ホールディングス	487,000	799.00	389,113,000	
名古屋鉄道	791,000	546.00	431,886,000	貸付有価証券 24,000株
日本通運	630,000	470.00	296,100,000	
ヤマトホールディングス	301,100	2,087.50	628,546,250	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
山九	214,000	470.00	100,580,000	
日本郵船	1,462,000	203.00	296,786,000	
A N Aホールディングス	3,024,000	305.10	922,622,400	
近鉄エクスプレス	29,100	1,330.00	38,703,000	貸付有価証券 900株(900株)
グリーン	97,500	578.00	56,355,000	
ネクソン	153,900	1,802.00	277,327,800	
ティーガイア	16,000	1,264.00	20,224,000	貸付有価証券 6,600株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	374,600	286.00	107,135,600	貸付有価証券 241,400株(12,700 株)
野村総合研究所	112,700	3,750.00	422,625,000	
フジ・メディア・ホールディングス	167,400	1,179.00	197,364,600	
オービック	55,400	5,710.00	316,334,000	
ヤフー	1,152,300	455.00	524,296,500	貸付有価証券 90,700株
トレンドマイクロ	78,100	3,845.00	300,294,500	貸付有価証券 10,300株
日本オラクル	25,800	5,890.00	151,962,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	36,400	1,974.00	71,853,600	貸付有価証券 24,600株
大塚商会	43,200	5,390.00	232,848,000	

USEN	73,300	315.00	23,089,500	貸付有価証券 46,000株
エイベックス・グループ・ホールディングス	29,600	1,419.00	42,002,400	貸付有価証券 500株(500株)
日本テレビホールディングス	146,800	1,770.00	259,836,000	
日本電信電話	966,000	4,739.00	4,577,874,000	
KDDI	1,468,000	2,991.50	4,391,522,000	
光通信	19,300	8,200.00	158,260,000	
NTTドコモ	1,240,000	2,547.50	3,158,900,000	
GMOインターネット	59,600	1,330.00	79,268,000	貸付有価証券 17,800株(12,600株)
東宝	114,700	2,842.00	325,977,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	99,300	5,320.00	528,276,000	
SCSK	38,200	4,210.00	160,822,000	
ソフトバンクグループ	644,500	5,604.00	3,611,778,000	
双日	1,012,800	209.00	211,675,200	
アルフレッサホールディングス	202,100	2,085.00	421,378,500	
シップヘルスケアホールディングス	32,600	2,761.00	90,008,600	
第一興商	37,900	4,635.00	175,666,500	
メディopalホールディングス	160,800	1,709.00	274,807,200	
伊藤忠商事	1,261,600	1,317.50	1,662,158,000	
丸紅	1,582,300	533.90	844,789,970	貸付有価証券 157,800株(36,500株)
豊田通商	179,100	2,331.00	417,482,100	
兼松	342,000	152.00	51,984,000	
三井物産	1,453,900	1,234.00	1,794,112,600	
日立ハイテクノロジーズ	55,700	3,015.00	167,935,500	
住友商事	1,012,100	1,073.50	1,086,489,350	
三菱商事	1,206,400	1,775.50	2,141,963,200	
岩谷産業	191,000	607.00	115,937,000	貸付有価証券 11,000株
東邦ホールディングス	51,500	2,262.00	116,493,000	貸付有価証券 34,500株(27,000株)
サンリオ	49,600	2,021.00	100,241,600	貸付有価証券 31,900株
日鉄住金物産	141,000	345.00	48,645,000	貸付有価証券

				27,000株
ミスミグループ本社	180,500	1,497.00	270,208,500	貸付有価証券 109,400株
ローソン	60,900	9,010.00	548,709,000	
エービーシー・マート	20,900	7,110.00	148,599,000	貸付有価証券 5,800株(5,400株)
ゲオホールディングス	26,800	1,918.00	51,402,400	貸付有価証券 18,000株(600株)
セリア	17,300	6,670.00	115,391,000	貸付有価証券 11,100株
MonotaRO	56,700	3,085.00	174,919,500	貸付有価証券 38,300株(19,000株)
J.フロントリテイリング	203,400	1,351.00	274,793,400	
マツモトキヨシホールディングス	33,200	5,690.00	188,908,000	
スタートトゥデイ	48,900	4,665.00	228,118,500	
三越伊勢丹ホールディングス	319,700	1,157.00	369,892,900	
ウエルシアホールディングス	18,600	6,110.00	113,646,000	
コスモス薬品	8,100	17,770.00	143,937,000	貸付有価証券 5,200株(3,300株)
セブン&アイ・ホールディングス	672,500	4,489.00	3,018,852,500	
ツルハホールディングス	36,900	10,940.00	403,686,000	
良品計画	18,500	23,460.00	434,010,000	貸付有価証券 1,400株
ドンキホーテホールディングス	104,000	3,630.00	377,520,000	貸付有価証券 9,700株
VTホールディングス	72,500	578.00	41,905,000	貸付有価証券 46,700株
ユナイテッドアローズ	22,900	4,335.00	99,271,500	
スギホールディングス	28,800	5,650.00	162,720,000	
ファミリーマート	49,400	5,640.00	278,616,000	貸付有価証券 16,100株
日本瓦斯	24,600	2,405.00	59,163,000	貸付有価証券 14,600株
AOKIホールディングス	36,700	1,262.00	46,315,400	
しまむら	18,700	14,220.00	265,914,000	
高島屋	234,000	842.00	197,028,000	貸付有価証券 9,000株(8,000株)
イオン	661,500	1,499.50	991,919,250	貸付有価証券 105,000株(4,600株)
イズミ	31,900	4,685.00	149,451,500	

ヤオコー	18,200	4,670.00	84,994,000	
ケーズホールディングス	34,000	3,575.00	121,550,000	貸付有価証券 500株(500株)
アインホールディングス	19,400	5,600.00	108,640,000	
ニトリホールディングス	69,500	10,220.00	710,290,000	
バローホールディングス	34,600	2,687.00	92,970,200	
ファーストリテイリング	32,200	30,490.00	981,778,000	貸付有価証券 6,200株(1,000株)
サンドラッグ	34,000	8,030.00	273,020,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,078,300	470.10	506,908,830	
新生銀行	1,391,000	134.00	186,394,000	貸付有価証券 224,000株
あおぞら銀行	1,017,000	359.00	365,103,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,928,700	482.80	2,379,576,360	
りそなホールディングス	1,880,900	372.60	700,823,340	貸付有価証券 241,800株(241,800株)
三井住友トラスト・ホールディングス	3,356,000	304.30	1,021,230,800	
三井住友フィナンシャルグループ	841,100	3,121.00	2,625,073,100	
西日本シティ銀行	524,000	184.00	96,416,000	
千葉銀行	620,000	513.00	318,060,000	貸付有価証券 32,000株(32,000株)
常陽銀行	581,000	358.00	207,998,000	貸付有価証券 228,000株(228,000株)
群馬銀行	357,000	427.00	152,439,000	貸付有価証券 44,000株(11,000株)
ふくおかフィナンシャルグループ	696,000	337.00	234,552,000	
静岡銀行	471,000	745.00	350,895,000	
十六銀行	269,000	307.00	82,583,000	
スルガ銀行	152,600	1,807.00	275,748,200	
八十二銀行	387,800	449.00	174,122,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,094,000	136.00	148,784,000	貸付有価証券 88,000株
広島銀行	474,000	371.00	175,854,000	
中国銀行	151,900	1,051.00	159,646,900	
伊予銀行	229,300	660.00	151,338,000	
セブン銀行	602,400	452.00	272,284,800	貸付有価証券

				77,200株
みずほフィナンシャルグループ	16,562,200	152.90	2,532,360,380	
山口フィナンシャルグループ	201,000	949.00	190,749,000	貸付有価証券 133,000株(81,000株)
北洋銀行	242,200	257.00	62,245,400	
京葉銀行	177,000	370.00	65,490,000	
SBIホールディングス	193,100	1,060.00	204,686,000	
ジャフコ	26,900	3,155.00	84,869,500	
大和証券グループ本社	1,504,000	643.70	968,124,800	
野村ホールディングス	3,093,600	447.00	1,382,839,200	
岡三証券グループ	137,000	548.00	75,076,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	184,500	546.00	100,737,000	貸付有価証券 2,000株
松井証券	78,700	883.00	69,492,100	貸付有価証券 500株
カブドットコム証券	142,500	343.00	48,877,500	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	357,100	2,927.50	1,045,410,250	
MS&ADインシュアランスグループホール	480,500	2,869.50	1,378,794,750	貸付有価証券 6,200株
ソニーフィナンシャルホールディングス	154,000	1,324.00	203,896,000	
第一生命保険	1,030,100	1,225.00	1,261,872,500	
東京海上ホールディングス	651,400	3,473.00	2,262,312,200	
T&Dホールディングス	586,000	982.70	575,862,200	
クレディセゾン	121,900	1,835.00	223,686,500	貸付有価証券 700株
芙蓉総合リース	18,400	4,515.00	83,076,000	
興銀リース	30,200	1,795.00	54,209,000	
東京センチュリーリース	37,800	3,925.00	148,365,000	
イオンフィナンシャルサービス	105,500	2,422.00	255,521,000	
アコム	323,000	558.00	180,234,000	貸付有価証券 216,500株
日立キャピタル	37,900	2,242.00	84,971,800	
オリックス	1,138,500	1,530.00	1,741,905,000	
三菱UFJリース	407,800	465.00	189,627,000	
日本取引所グループ	472,100	1,627.00	768,106,700	
ヒューリック	335,100	1,041.00	348,839,100	貸付有価証券 138,300株(4,500株)

野村不動産ホールディングス	106,600	1,989.00	212,027,400	
プレサンスコーポレーション	5,500	4,010.00	22,055,000	貸付有価証券 3,500株
東急不動産ホールディングス	389,000	746.00	290,194,000	
飯田グループホールディングス	148,900	2,109.00	314,030,100	
パーク24	81,200	3,125.00	253,750,000	貸付有価証券 27,000株
三井不動産	852,000	2,552.00	2,174,304,000	
三菱地所	1,196,000	2,006.50	2,399,774,000	貸付有価証券 311,000株
東京建物	175,600	1,350.00	237,060,000	
住友不動産	385,000	3,043.00	1,171,555,000	
大京	299,000	173.00	51,727,000	貸付有価証券 36,000株
レオパレス21	189,400	651.00	123,299,400	
スターツコーポレーション	24,600	2,412.00	59,335,200	
住友不動産販売	11,600	2,012.00	23,339,200	
タカラレーベン	70,100	603.00	42,270,300	貸付有価証券 12,500株 (5,800株)
イオンモール	103,700	1,545.00	160,216,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	99,900	1,048.00	104,695,200	
ミクシィ	34,100	3,675.00	125,317,500	
日本M&Aセンター	26,300	6,460.00	169,898,000	貸付有価証券 5,400株
テンプホールディングス	119,300	1,654.00	197,322,200	
クックパッド	37,900	1,576.00	59,730,400	貸付有価証券 24,400株
総合警備保障	56,800	6,010.00	341,368,000	貸付有価証券 12,900株
カカコム	122,200	1,997.00	244,033,400	貸付有価証券 70,400株 (35,100株)
エムスリー	147,300	2,736.00	403,012,800	
ディー・エヌ・エー	76,300	1,876.00	143,138,800	貸付有価証券 5,800株
博報堂DYホールディングス	235,800	1,213.00	286,025,400	
電通	189,600	5,270.00	999,192,000	貸付有価証券 73,500株 (1,800株)
みらかホールディングス	43,400	4,545.00	197,253,000	
オリエンタルランド	184,000	7,766.00	1,428,944,000	貸付有価証券

				83,400 株 (2,000 株)
リゾートトラスト	71,400	2,348.00	167,647,200	貸付有価証券 28,000 株
ユー・エス・エス	206,000	1,691.00	348,346,000	
サイバーエージェント	41,600	5,030.00	209,248,000	貸付有価証券 23,700 株 (23,700 株)
楽天	796,100	1,183.00	941,786,300	
リロ・ホールディング	8,500	15,070.00	128,095,000	貸付有価証券 1,100 株
エイチ・アイ・エス	27,700	3,035.00	84,069,500	貸付有価証券 17,800 株 (300 株)
カナモト	23,700	2,445.00	57,946,500	貸付有価証券 14,300 株
セコム	177,000	7,906.00	1,399,362,000	
ベネッセホールディング ス	57,000	3,170.00	180,690,000	
イオンディライト	16,400	3,350.00	54,940,000	
小計	銘柄数 : 400 組入時価比率 : 97.7%		226,826,185,830 100.0%	
合計			226,826,185,830	

(注 1) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注 2) 備考欄の貸付有価証券の () 内は、委託者の利害関係人である野村証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(平成 28 年 4 月 7 日現在)

該当事項はありません。

第 2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。